

นโยบายการพิจารณาปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ในการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด ("บริษัทจัดการ") ในฐานะผู้บริหารจัดการลงทุน ตระหนักถึงการทำหน้าที่ในการบริหารจัดการลงทุนอย่างมีธรรมาภิบาล มีความรับผิดชอบต่อ ชี้อัตถ์ สุจริต โปร่งใส เพื่อผลประโยชน์สูงสุดต่อลูกค้าและผู้ถือหุ้นลงทุน รวมถึงเป็นแรงกระตุ้นและผลักดันให้บริษัทจดทะเบียนดำเนินธุรกิจอย่างมีบรรษัทภิบาลด้วยความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม (ESG) เพื่อการสร้างคุณค่าให้กิจการอย่างยั่งยืน อันส่งผลต่อการเพิ่มมูลค่าที่ดีในการลงทุนให้แก่ลูกค้าและผลตอบแทนที่ยั่งยืนในระยะยาว รวมทั้งส่งผลดีต่อเนื่องต่อระบบเศรษฐกิจโดยรวมให้เติบโตอย่างมั่นคง

บริษัทจัดการจึงได้จัดทำนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ในการลงทุนที่เป็นลายลักษณ์อักษร และประกาศเจตนารมณ์ที่จะปฏิบัติตามหลักธรรมาภิบาลการลงทุน รวมทั้งบูรณาการมาตรฐาน ESG รวมถึง climate change ในกระบวนการลงทุนอย่างมีประสิทธิภาพ ทั้งนี้ บริษัทจัดการได้นำนโยบาย ESG รวมถึง climate change เป็นแนวทางพิจารณาในกระบวนการวิเคราะห์และการตัดสินใจลงทุน รวมถึงนโยบายการใช้สิทธิออกเสียงในฐานะผู้ถือหุ้นหลักทรัพย์สินในนามกองทุน

หลักการของนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ในการลงทุน

1. บริษัทจัดการกำหนดนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ในการลงทุนที่ชัดเจนเป็นลายลักษณ์อักษร โดยครอบคลุมในเรื่องดังต่อไปนี้
 - 1.1. ขอบข่ายของนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ในการลงทุน
 - 1.2. การนำประเด็นด้าน ESG รวมถึง climate change มาประกอบการคัดเลือก และการวิเคราะห์การลงทุน
 - 1.3. การกำหนดรายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่ต้องติดตามตรวจสอบประเด็นด้าน ESG (Watch List) และหลักทรัพย์ที่ห้ามลงทุนเพิ่ม (Restricted List)
 - 1.4. การเข้าไปพบและเจรจาประเด็นข้อสังเกตหรือข้อกังวลด้าน ESG กับบริษัทที่ลงทุน และการร่วมมือกับผู้ลงทุนและผู้มีส่วนได้เสียรายอื่นในการผลักดันให้บริษัทจดทะเบียนดำเนินธุรกิจไปในแนวทางที่คำนึงถึง ESG (Collective Action)
 - 1.5. แนวทางการใช้สิทธิออกเสียงในฐานะผู้ถือหุ้นหลักทรัพย์สินในนามกองทุน
2. บริษัทจัดการนำปัจจัยด้าน ESG รวมถึง climate change มาประกอบการพิจารณา และการวิเคราะห์การลงทุน

ในการคัดเลือกหลักทรัพย์เข้ามาเป็นหลักทรัพย์ที่สามารถลงทุนได้ของบริษัทจัดการ คณะกรรมการลงทุนจะพิจารณาคะแนนด้าน ESG รวมถึงปัจจัยด้าน climate change ซึ่งจะถูกวิเคราะห์และนำเสนอโดยบุคลากรด้านการลงทุนภายในบริษัทจัดการ ร่วมกับปัจจัยเชิงปริมาณ และปัจจัยเชิงคุณภาพอื่นๆ ทั้งนี้ คะแนน ESG ดังกล่าวจะได้รับการประเมินและทบทวนเป็นประจำทุกปี หรือเมื่อเกิดเหตุการณ์ที่ก่อให้เกิดผลกระทบด้าน ESG อย่างมีนัยสำคัญ

3. การกำหนดรายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่ต้องติดตามตรวจสอบประเด็นด้าน ESG (Watch List) และหลักทรัพย์ที่ห้ามลงทุนเพิ่ม (Restricted List)

บริษัทจัดการโดยกลุ่มการลงทุนจะนำ Watch List และ Restricted List จากการลงมติพิจารณาของคณะกรรมการ ESG Policy และ Collective Action ซึ่งคณะกรรมการสมาคมบริษัทจัดการลงทุนได้จัดตั้งขึ้น มาประยุกต์ใช้กับหลักทรัพย์ที่สามารถลงทุนได้ของบริษัทจัดการ

โดยหลักทรัพย์ที่ถูกลงมติให้อยู่ใน Watch List ประกอบด้วย

- 1) กรรมการ หรือผู้บริหารบริษัทจดทะเบียนฝ่าฝืนหรือละเลยไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ หรือกฎหมาย
- 2) บริษัทจดทะเบียนฝ่าฝืนหรือละเลยไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ หรือกฎหมาย
- 3) บริษัทจดทะเบียนถูกกล่าวโทษจากหน่วยงานภาครัฐ หรือฝ่ายกำกับ แต่ยังไม่มีความตัดสินจากศาลชั้นต้น และ
- 4) บริษัทจดทะเบียนไม่นำส่งงบการเงินให้ตลาดหลักทรัพย์ภายในเวลาที่กำหนด

ในขณะที่หลักทรัพย์ที่ถูกลงมติให้อยู่ใน Restricted List ถูกแบ่งออกเป็น 3 กรณี ได้แก่

- 1) กรรมการ หรือผู้บริหารบริษัทจดทะเบียนได้รับมาตรการลงโทษจากคำวินิจฉัย หรือคำพิพากษาจากศาลชั้นต้น
- 2) บริษัทจดทะเบียนฝ่าฝืนหรือละเลยไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ และ
- 3) บริษัทจดทะเบียนได้รับมาตรการลงโทษจากคำวินิจฉัย หรือคำพิพากษาจากศาลชั้นต้น

4. บริษัทจัดการจะติดตาม เข้าไปพบและเจรจาประเด็นข้อสังเกตหรือข้อกังวลด้าน ESG รวมถึง climate change กับบริษัทที่ลงทุนอย่างต่อเนื่อง

- 4.1. บริษัทจัดการจะนำปัจจัยด้าน ESG รวมถึง climate change มาประกอบแนวนโยบายและแนวปฏิบัติด้านการถือครองหลักทรัพย์ ทั้งนี้ บริษัทจัดการตระหนักว่า การพบปะกับผู้บริหารของบริษัทจดทะเบียนเป็นหัวใจสำคัญในกระบวนการวิเคราะห์การลงทุน โดยบุคลากรด้านการลงทุนของบริษัทจัดการจะใช้สิทธิในการถือครองหลักทรัพย์ เพื่อเข้าไปพบและเจรจากับบริษัทที่ลงทุนหรือจัดทำแบบสอบถาม ESG ในประเด็นข้อสังเกตหรือข้อกังวลด้าน ESG รวมถึง climate change ที่มีความเสี่ยงอย่างมีนัยสำคัญต่อผลการดำเนินงานของบริษัทที่ลงทุน
- 4.2. หากมีข้อมูล ข่าวสาร หรือประเด็นทางด้าน ESG รวมถึง climate change ของบริษัทที่ลงทุนผ่านสื่อ หรือช่องทางอื่นๆ ที่อาจส่งผลกระทบต่อราคาหรือมูลค่าของหลักทรัพย์ และยังไม่มีความชี้แจงจากบริษัทที่ลงทุนภายใน 5 วันทำการ บริษัทจัดการจะมอบหมายให้ผู้จัดการกองทุน และ/หรือนักวิเคราะห์ ส่งอีเมลล์ หรือโทรศัพท์ หรือติดต่อสอบถามด้วยวิธีการที่เหมาะสม เพื่อสอบถามข้อเท็จจริงจากบริษัทที่ลงทุน
- 4.3. บริษัทจัดการกำหนดให้แต่ละกองทุนที่บริษัทได้ลงทุนต้องคำนึงถึงประเด็นด้าน ESG รวมถึง climate change ปัจจัยดังกล่าวจะเป็นส่วนหนึ่งในกระบวนการทบทวนประจำปี ซึ่งแบบสอบถามด้าน ESG ประจำปีจะใช้เพื่อประเมินความมุ่งมั่นในแนวทางดำเนินการด้าน ESG ของแต่ละกองทุน

- 5. บริษัทจัดการจะดำเนินการร่วมกับผู้ลงทุนและผู้มีส่วนได้เสียรายอื่นตามความเหมาะสม (Collective Engagement)**
- 5.1 หากบริษัทจดทะเบียนถูกลงมติจากการพิจารณาของคณะกรรมการนโยบาย ESG Policy และ Collective Action ให้อยู่ใน Watch List บริษัทจัดการจะร่วมกับผู้ลงทุนและผู้มีส่วนได้เสียรายอื่น เพื่อทำหนังสือถึง คณะกรรมการบริษัทจดทะเบียนเพื่อสอบถามข้อเท็จจริง ผลกระทบ และแนวทางแก้ไข และเข้าพบ คณะกรรมการหรือคณะกรรมการตรวจสอบ หรือคณะกรรมการกำกับดูแลกิจการ หรือบุคคลอื่นใดที่เป็นตัวแทนที่เหมาะสมของบริษัทจดทะเบียน
 - 5.2 หากบริษัทจดทะเบียนถูกลงมติจากการพิจารณาของคณะกรรมการนโยบาย ESG Policy และ Collective Action ให้อยู่ใน Restricted List บริษัทจัดการจะไม่ลงทุนเพิ่มเติมในกิจการนั้นๆ ไม่ว่าจะเป็นตราสารทุน ตราสารหนี้ หรือสินทรัพย์อื่นใดของบริษัทจดทะเบียนดังกล่าวเป็นเวลาไม่น้อยกว่า 3 เดือน หรือจนกว่าบริษัทจดทะเบียนได้ดำเนินการปรับปรุงแก้ไขปัญหาในระดับที่น่าพึงพอใจแล้ว และสมาคมบริษัทจัดการลงทุนได้ประกาศให้สมาชิกนำหลักทรัพย์ดังกล่าวออกจาก Restricted List
 - 5.3 สำหรับกองทุนดัชนี การลงทุนแบบ Passive และกองทุนส่วนบุคคลที่อาจมีนโยบายที่ไม่เอื้ออำนวยต่อการระดม การลงทุน บริษัทจัดการจะเข้าร่วมประชุมออกเสียงในคณะกรรมการนโยบาย ESG Policy และ Collective Action เพื่อกำหนดแนวทางการดำเนินการต่อบริษัทจดทะเบียนที่มีประเด็นลบด้าน ESG
- 6. บริษัทจะเปิดเผยนโยบายการใช้สิทธิออกเสียงและผลการใช้สิทธิออกเสียงในบริษัทที่ลงทุน**
- 6.1 บริษัทจัดการจะสนับสนุนบรรษัทภิบาลผ่านนโยบายการใช้สิทธิออกเสียงของบริษัทจัดการ โดยบริษัทจัดการ ยึดถือว่าการใช้สิทธิออกเสียงเป็นกลไกการควบคุมให้บริษัทจดทะเบียนปฏิบัติตามหลักธรรมาภิบาลเพื่อ ก่อให้เกิดประโยชน์สูงสุดต่อผู้ลงทุน
 - 6.2 บริษัทจัดการจะพิจารณาวาระการประชุมทั้งหมด และจะลงคะแนนใช้สิทธิออกเสียงโดยคำนึงถึงผลประโยชน์ใน ระยะยาวต่อผู้ลงทุนเป็นสำคัญ
 - 6.3 การพิจารณาออกเสียงจะถูกนำเสนอโดยบุคลากรด้านการลงทุนของบริษัทจัดการ และจะมีคณะกรรมการลงทุน เป็นผู้พิจารณาการใช้สิทธิออกเสียง ก่อนการใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุม บริษัทจัดการจะดำเนินการเปิดเผย ข้อมูลการใช้สิทธิออกเสียง รวมถึงการชี้แจงเหตุผลในการพิจารณาออกเสียง “ไม่เห็นด้วย” ให้ผู้ลงทุนได้เข้าถึง และรับทราบ
 - 6.4 ในกรณีที่บริษัทจดทะเบียนอยู่ใน Watch List บริษัทจัดการจะออกเสียงไม่เห็นด้วยในประเด็น ESG รวมถึง ประเด็น climate change ของบริษัทจดทะเบียนในการประชุมผู้ถือหุ้น หรือการประชุมผู้ถือหุ้นกู้ หากเป็น ความผิดเฉพาะบุคคล บริษัทจัดการจะออกเสียงไม่เห็นด้วยในการแต่งตั้งบุคคลนั้นๆ เป็นกรรมการ

6.5 ในกรณีที่บริษัทจดทะเบียนอยู่ใน Restricted List บริษัทจัดการจะออกเสียงไม่เห็นด้วยในประเด็น ESG รวมถึงประเด็น climate change ของบริษัทจดทะเบียนในการประชุมผู้ถือหุ้น หรือการประชุมผู้ถือหุ้นกู้ หากเป็นความผิดเฉพาะบุคคลและระดับความผิดไม่รุนแรง บริษัทจัดการจะคัดค้านการเสนอชื่อบุคคลดังกล่าวเข้าดำรงตำแหน่งกรรมการในบริษัทจดทะเบียนนั้น และบริษัทจดทะเบียนอื่นๆ ที่บุคคลนั้นดำรงตำแหน่งกรรมการเป็นระยะเวลา 1 ปี หากเป็นความผิดเฉพาะบุคคลและเป็นระดับความผิดขั้นรุนแรง บริษัทจัดการจะคัดค้านการเสนอชื่อบุคคลดังกล่าวเข้าดำรงตำแหน่งกรรมการในบริษัทจดทะเบียนนั้น และบริษัทจดทะเบียนอื่นๆ ที่บุคคลนั้นดำรงตำแหน่งกรรมการ รวมถึงการกลับเข้ามาเป็นกรรมการต่อเป็นระยะเวลา 3 ปี

7 บริษัทจัดการจะเปิดเผยนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ในการลงทุน

บริษัทจัดการจะสื่อสาร และเปิดเผยนโยบายการพิจารณาปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล (ESG) ในการลงทุน แก่ลูกค้าและผู้ถือหน่วยลงทุนทราบผ่านทางเว็บไซต์ของบริษัทจัดการ

.....